

平成27年7月期（平成26年7月16日～平成27年7月15日）決算短信

平成27年8月26日

上場取引所

東証

ファンド名 東証電気機器株価指数連動型上場投資信託  
 コード番号 ( 1613 )  
 連動対象指標 東証電気機器株価指数  
 主要投資資産 株式  
 売買単位 10口  
 管理会社 野村アセットマネジメント株式会社 URL <http://www.nomura-am.co.jp>  
 代表者名 CEO兼執行役社長 渡邊 国夫  
 問合せ先責任者 商品企画部長 渡部 昭裕 TEL (03)-3241-9511

有価証券報告書提出予定日 平成27年9月30日  
 分配金支払開始日 平成27年8月21日

I ファンドの運用状況

1. 平成27年7月期の運用状況（平成26年7月16日～平成27年7月15日）

(1)資産内訳 (百万円未満切捨て)

	主要投資資産		現金・預金・その他の資産 (負債控除後)		合計(純資産)	
	金額	構成比	金額	構成比	金額	構成比
	百万円	%	百万円	%	百万円	%
平成27年7月期	2,404	(99.8)	5	(0.2)	2,410	(100)
平成26年7月期	1,864	(99.6)	7	(0.4)	1,871	(100)

(2)設定・交換実績 (千口未満切捨て)

	前計算期間末 発行済口数(①)	設定口数(②)	交換口数(③)	当計算期間末 発行済口数 (①+②-③)
	千口	千口	千口	千口
平成27年7月期	1,141	0	0	1,141
平成26年7月期	1,141	0	0	1,141

(3)基準価額

	総資産 (①)	負債 (②)	純資産 (③(①-②))	100口当り基準価額 (③/当計算期間末発行済口数) × 100
	百万円	百万円	百万円	円
平成27年7月期	2,443	33	2,410	211,279
平成26年7月期	1,896	24	1,871	164,022

(4)分配金

	100口当り分配金
	円
平成27年7月期	2,660.00
平成26年7月期	1,980.00

2. 会計方針の変更

- ① 会計基準等の改正に伴う変更 有  無   
 ② ①以外の変更 有  無

## Ⅱ 財務諸表等

## 東証電気機器株価指数連動型上場投資信託

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第 12 期 (平成 26 年 7 月 15 日現在)	第 13 期 (平成 27 年 7 月 15 日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	28,673,689	35,055,045
株式	1,864,161,600	2,404,972,700
未収配当金	3,337,200	3,884,200
未収利息	51	66
流動資産合計	1,896,172,540	2,443,912,011
資産合計	1,896,172,540	2,443,912,011
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	22,591,859	30,350,679
未払受託者報酬	658,096	904,115
未払委託者報酬	1,410,138	1,937,321
その他未払費用	18,736	25,770
流動負債合計	24,678,829	33,217,885
負債合計	24,678,829	33,217,885
純資産の部		
元本等		
元本	2,146,226,643	2,146,226,643
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△274,732,932	264,467,483
(分配準備積立金)	8,021	27,994
元本等合計	1,871,493,711	2,410,694,126
純資産合計	1,871,493,711	2,410,694,126
負債純資産合計	1,896,172,540	2,443,912,011

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 12 期 自 平成 25 年 7 月 16 日 至 平成 26 年 7 月 15 日	第 13 期 自 平成 26 年 7 月 16 日 至 平成 27 年 7 月 15 日
営業収益		
受取配当金	26,472,696	35,671,891
受取利息	8,991	10,100
有価証券売買等損益	294,879,232	539,180,442
その他収益	549	905
営業収益合計	321,361,468	574,863,338
営業費用		
受託者報酬	1,255,500	1,675,110
委託者報酬	2,690,217	3,589,390
その他費用	35,743	47,744
営業費用合計	3,981,460	5,312,244

営業利益又は営業損失 (△)	317,380,008	569,551,094
経常利益又は経常損失 (△)	317,380,008	569,551,094
当期純利益又は当期純損失 (△)	317,380,008	569,551,094
一部交換に伴う当期純利益金額の分配額又は一部交換に伴う当期純損失金額の分配額 (△)	-	-
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	△569,521,081	△274,732,932
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	22,591,859	30,350,679
期末剰余金又は期末欠損金 (△)	△274,732,932	264,467,483

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	株式 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	受取配当金 受取配当金は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、平成 26 年 7 月 16 日から平成 27 年 7 月 15 日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

第 12 期 平成 26 年 7 月 15 日現在	第 13 期 平成 27 年 7 月 15 日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 1,141,003 口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 1,141,003 口
2. 投資信託財産計算規則第 55 条の 6 第 1 項第 10 号に規定する額 元本の欠損 274,732,932 円	
3. 計算期間の末日における 1 単位当たりの純資産の額 1 口当たり純資産額 1,640.22 円 (100 口当たり純資産額) (164,022 円)	2. 計算期間の末日における 1 単位当たりの純資産の額 1 口当たり純資産額 2,112.79 円 (100 口当たり純資産額) (211,279 円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 12 期 自 平成 25 年 7 月 16 日 至 平成 26 年 7 月 15 日	第 13 期 自 平成 26 年 7 月 16 日 至 平成 27 年 7 月 15 日																																																						
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																																						
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td>A</td> <td>26,482,236 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>99,104 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>26,581,340 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>3,981,460 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>22,599,880 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>22,591,859 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>8,021 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>1,141,003 口</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	26,482,236 円	分配準備積立金	B	99,104 円	配当等収益合計額	C=A+B	26,581,340 円	経費	D	3,981,460 円	収益分配可能額	E=C-D	22,599,880 円	収益分配金	F	22,591,859 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	8,021 円	口数	H	1,141,003 口	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当期配当等収益額</td> <td>A</td> <td>35,682,896 円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金</td> <td>B</td> <td>8,021 円</td> </tr> <tr> <td>配当等収益合計額</td> <td>C=A+B</td> <td>35,690,917 円</td> </tr> <tr> <td>経費</td> <td>D</td> <td>5,312,244 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配可能額</td> <td>E=C-D</td> <td>30,378,673 円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金</td> <td>F</td> <td>30,350,679 円</td> </tr> <tr> <td>次期繰越金(分配準備積立金)</td> <td>G=E-F</td> <td>27,994 円</td> </tr> <tr> <td>口数</td> <td>H</td> <td>1,141,003 口</td> </tr> </tbody> </table>	項目			当期配当等収益額	A	35,682,896 円	分配準備積立金	B	8,021 円	配当等収益合計額	C=A+B	35,690,917 円	経費	D	5,312,244 円	収益分配可能額	E=C-D	30,378,673 円	収益分配金	F	30,350,679 円	次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	27,994 円	口数	H	1,141,003 口
項目																																																							
当期配当等収益額	A	26,482,236 円																																																					
分配準備積立金	B	99,104 円																																																					
配当等収益合計額	C=A+B	26,581,340 円																																																					
経費	D	3,981,460 円																																																					
収益分配可能額	E=C-D	22,599,880 円																																																					
収益分配金	F	22,591,859 円																																																					
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	8,021 円																																																					
口数	H	1,141,003 口																																																					
項目																																																							
当期配当等収益額	A	35,682,896 円																																																					
分配準備積立金	B	8,021 円																																																					
配当等収益合計額	C=A+B	35,690,917 円																																																					
経費	D	5,312,244 円																																																					
収益分配可能額	E=C-D	30,378,673 円																																																					
収益分配金	F	30,350,679 円																																																					
次期繰越金(分配準備積立金)	G=E-F	27,994 円																																																					
口数	H	1,141,003 口																																																					

100 口当たり分配金	I=F/H×100	1,980 円	100 口当たり分配金	I=F/H×100	2,660 円
-------------	-----------	---------	-------------	-----------	---------

## (金融商品に関する注記)

## (1) 金融商品の状況に関する事項

第 12 期 自 平成 25 年 7 月 16 日 至 平成 26 年 7 月 15 日	第 13 期 自 平成 26 年 7 月 16 日 至 平成 27 年 7 月 15 日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の 2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>○市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>○信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>○流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>	<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

## (2) 金融商品の時価等に関する事項

第 12 期 平成 26 年 7 月 15 日現在	第 13 期 平成 27 年 7 月 15 日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>株式</p> <p>(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>同左</p>

## (関連当事者との取引に関する注記)

第 12 期 自 平成 25 年 7 月 16 日 至 平成 26 年 7 月 15 日	第 13 期 自 平成 26 年 7 月 16 日 至 平成 27 年 7 月 15 日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。	同左

## (その他の注記)

## 1 元本の移動

第 12 期	第 13 期
--------	--------

自 平成 25 年 7 月 16 日 至 平成 26 年 7 月 15 日		自 平成 26 年 7 月 16 日 至 平成 27 年 7 月 15 日	
期首元本額	2,146,226,643 円	期首元本額	2,146,226,643 円
期中追加設定元本額	0 円	期中追加設定元本額	0 円
期中一部交換元本額	0 円	期中一部交換元本額	0 円

## 2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第 12 期 自 平成 25 年 7 月 16 日 至 平成 26 年 7 月 15 日	第 13 期 自 平成 26 年 7 月 16 日 至 平成 27 年 7 月 15 日
	損益に含まれた評価差額 (円)	損益に含まれた評価差額 (円)
株式	295,109,229	535,318,633
合計	295,109,229	535,318,633

## 3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

## (4) 【附属明細表】

## 第 1 有価証券明細表

(1) 株式(平成 27 年 7 月 15 日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	日本円	イビデン	5,300	2,030.00	10,759,000	
		コニカミノルタ	19,200	1,518.00	29,145,600	
		ブラザー工業	10,400	1,732.00	18,012,800	
		ミネベア	12,000	1,947.00	23,364,000	
		日立製作所	194,000	774.50	150,253,000	
		東芝	170,000	374.90	63,733,000	
		三菱電機	81,000	1,516.50	122,836,500	
		富士電機	22,000	523.00	11,506,000	
		東洋電機製造	2,000	411.00	822,000	
		安川電機	9,900	1,562.00	15,463,800	
		シンフォニアテクノロジー	6,000	233.00	1,398,000	
		明電舎	7,000	427.00	2,989,000	
		オリジン電気	1,000	412.00	412,000	
		山洋電気	2,000	947.00	1,894,000	
		デンヨー	700	1,999.00	1,399,300	
		東芝テック	6,000	634.00	3,804,000	
		芝浦メカトロニクス	1,000	263.00	263,000	
マブチモーター	2,300	7,560.00	17,388,000			

日本電産	8,900	9,660.00	85,974,000
東光高岳	400	1,640.00	656,000
宮越ホールディングス	300	640.00	192,000
ダイヘン	4,000	625.00	2,500,000
田淵電機	900	1,138.00	1,024,200
ヤーマン	100	1,576.00	157,600
JVCケンウッド	5,900	291.00	1,716,900
ミマキエンジニアリング	500	851.00	425,500
第一精工	300	1,842.00	552,600
日新電機	1,900	852.00	1,618,800
大崎電気工業	1,000	681.00	681,000
オムロン	8,700	5,350.00	46,545,000
日東工業	1,300	2,867.00	3,727,100
I D E C	1,000	1,115.00	1,115,000
不二電機工業	100	1,536.00	153,600
ジーエス・ユアサ コーポレーション	16,000	481.00	7,696,000
サクサホールディングス	2,000	302.00	604,000
メルコホールディングス	400	2,273.00	909,200
テクノメディカ	200	2,778.00	555,600
日本電気	104,000	378.00	39,312,000
富士通	78,000	680.80	53,102,400
沖電気工業	28,000	256.00	7,168,000
岩崎通信機	4,000	91.00	364,000
電気興業	2,000	572.00	1,144,000
サンケン電気	4,000	749.00	2,996,000
ナカヨ	1,000	358.00	358,000
アイホン	500	2,040.00	1,020,000
ルネサスエレクトロニクス	4,200	812.00	3,410,400
セイコーエプソン	11,000	2,300.00	25,300,000
ワコム	6,400	459.00	2,937,600
アルバック	1,400	1,814.00	2,539,600
アクセル	400	1,780.00	712,000
E I Z O	700	2,844.00	1,990,800
ジャパンディスプレイ	16,600	431.00	7,154,600
日本信号	2,200	1,353.00	2,976,600

京三製作所	2,000	378.00	756,000
能美防災	1,100	1,448.00	1,592,800
ホーチキ	600	937.00	562,200
エレコム	300	2,885.00	865,500
日本無線	2,000	425.00	850,000
パナソニック	98,300	1,621.50	159,393,450
シャープ	68,000	174.00	11,832,000
アンリツ	4,800	833.00	3,998,400
富士通ゼネラル	2,000	1,598.00	3,196,000
日立国際電気	2,000	1,845.00	3,690,000
ソニー	52,800	3,452.50	182,292,000
TDK	4,900	8,840.00	43,316,000
帝国通信工業	2,000	221.00	442,000
ミツミ電機	2,800	851.00	2,382,800
タムラ製作所	3,000	477.00	1,431,000
アルプス電気	6,400	3,670.00	23,488,000
池上通信機	3,000	171.00	513,000
パイオニア	12,100	228.00	2,758,800
日本電波工業	700	916.00	641,200
鈴木	200	700.00	140,000
日本トリム	200	3,180.00	636,000
ローランド ディー. ジー.	300	3,335.00	1,000,500
フォスター電機	900	2,694.00	2,424,600
クラリオン	4,000	332.00	1,328,000
SMK	2,000	530.00	1,060,000
ヨコオ	600	783.00	469,800
東光	2,000	335.00	670,000
ティアック	4,000	46.00	184,000
ホシデン	2,400	752.00	1,804,800
ヒロセ電機	1,400	16,550.00	23,170,000
日本航空電子工業	2,000	2,943.00	5,886,000
TOA	900	1,377.00	1,239,300
日立マクセル	1,600	1,920.00	3,072,000
古野電気	1,000	923.00	923,000
ユニデンホールディングス	2,000	222.00	444,000
アルパイン	1,900	2,167.00	4,117,300

スミダコーポレーション	700	893.00	625,100
アイコム	400	2,979.00	1,191,600
リオン	300	1,839.00	551,700
船井電機	800	1,393.00	1,114,400
横河電機	8,100	1,462.00	11,842,200
新電元工業	3,000	582.00	1,746,000
アズビル	2,600	3,115.00	8,099,000
東亜ディーケーケー	300	551.00	165,300
日本光電工業	3,400	2,798.00	9,513,200
チノー	300	1,273.00	381,900
共和電業	1,000	500.00	500,000
日本電子材料	300	747.00	224,100
堀場製作所	1,500	5,220.00	7,830,000
アドバンテスト	5,500	1,289.00	7,089,500
小野測器	400	985.00	394,000
エスペック	900	1,413.00	1,271,700
パナソニック デバイス SUNX	700	850.00	595,000
キーエンス	1,800	68,030.00	122,454,000
日置電機	400	2,917.00	1,166,800
シスメックス	6,300	7,450.00	46,935,000
メガチップス	800	1,417.00	1,133,600
OBARA GROUP	500	6,150.00	3,075,000
コーセル	1,200	1,411.00	1,693,200
新日本無線	1,000	763.00	763,000
オブテックス	600	2,635.00	1,581,000
千代田インテグレ	400	2,873.00	1,149,200
レーザーテック	800	1,632.00	1,305,600
スタンレー電気	5,800	2,514.00	14,581,200
岩崎電気	3,000	259.00	777,000
ウシオ電機	4,900	1,550.00	7,595,000
岡谷電機産業	400	415.00	166,000
ヘリオス テクノ ホールディング	700	420.00	294,000
日本セラミック	500	1,722.00	861,000
遠藤照明	400	1,369.00	547,600
日本デジタル研究所	700	1,685.00	1,179,500
古河電池	1,000	796.00	796,000



双信電機	400	411.00	164,400
山一電機	900	1,228.00	1,105,200
図研	600	1,234.00	740,400
日本電子	3,000	524.00	1,572,000
カシオ計算機	8,100	2,476.00	20,055,600
ファナック	8,400	24,280.00	203,952,000
日本シイエムケイ	2,100	306.00	642,600
エンプラス	400	5,020.00	2,008,000
大真空	1,000	275.00	275,000
ローム	4,000	7,570.00	30,280,000
浜松ホトニクス	6,300	3,425.00	21,577,500
三井ハイテック	1,100	818.00	899,800
新光電気工業	3,000	854.00	2,562,000
京セラ	13,200	6,470.00	85,404,000
太陽誘電	4,200	1,614.00	6,778,800
村田製作所	8,500	19,565.00	166,302,500
ユーシン	1,100	721.00	793,100
双葉電子工業	1,400	2,175.00	3,045,000
北陸電気工業	3,000	174.00	522,000
ニチコン	2,500	932.00	2,330,000
日本ケミコン	7,000	362.00	2,534,000
KOA	1,100	1,252.00	1,377,200
市光工業	2,000	286.00	572,000
小糸製作所	4,800	4,770.00	22,896,000
ミツバ	1,500	2,990.00	4,485,000
スター精密	1,500	1,908.00	2,862,000
S C R E E Nホールディングス	8,000	758.00	6,064,000
キヤノン電子	700	2,399.00	1,679,300
キヤノン	46,800	4,000.00	187,200,000
リコー	24,300	1,252.50	30,435,750
MUTOHホールディングス	1,000	374.00	374,000
東京エレクトロン	6,800	8,087.00	54,991,600
小計	銘柄数：157		2,404,972,700
	組入時価比率：99.8%		100.0%
合計			2,404,972,700

(注1)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

(2) 株式以外の有価証券(平成 27 年 7 月 15 日現在)

該当事項はありません。

第 2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。